

圆信永丰优加生活股票型证券投资基金

2018年第四季度报告

报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(只), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 5 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(只), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 通过查阅中国证监会、中国银保监会网站公开目录“行政处罚决定”

5.11.2 本基金前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

基金管理人:圆信永丰基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
重要提示
基金产品概况

3.1 主要财务指标

Table with 5 columns: 主要财务指标, 报告期(2018年10月01日至2018年12月31日), 单位:人民币元

注:1.本期指2018年10月1日至2018年12月31日,上述基金业绩指标不包括基金

注:2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值

变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 5 columns: 期间, 净值增长率, 业绩比较基准, 超额收益, 业绩比较基准

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准

收益变动的比较

截至报告期末圆信永丰优加生活股票型证券投资基金资产净值为1,213.31

Table with 5 columns: 代码, 名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明

报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为,勤勉尽责地

为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《中华人民共和国证券投资基

基金法》及其他有关法律法规,该基金基金合同的规定。基金经理对个券和投资组

合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制,基金投资组合符合基金合同和法律法

规的要求。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导

意见》等相关法律法规和《圆信永丰基金管理有限公司公平交易管理办法》的

各项要求,严格规范范围内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等

活动,通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析,以确保基金管理人

的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理

活动的各个环节均得到公平对待。

基金管理人各类基金资产、特定资产管理计划资产独立运作。对于交易所

市场投资,本公司执行集中交易制度,确保不同投资组合在买卖同一证券时,按照

价格优先、时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量;对于

银行间市场投资,基金管理人通过交易对手控制和询价机制,严格防范对手风险

并检查价格公允性;对于申购赎回行为,基金管理人遵循价格优先、比例分配

的原则,根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内,通过每季度对年度对不同投资组合之间的收益率差异比较,对

同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析,基金管理人未发现整体

公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析,基金管理人

未发现存在有可能导致不公平交易和利益输送等的异常交易行为。

基金管理人旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制

方面,未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度,A股市场继续下跌,加上今年的仓位尽量贴近80%的契约要求下限,

自6月初PMI数据发出了经济开始加速下行的信号以来,我们至今还未观察到

经济出现好转的迹象,甚至11月开始,工业企业、国有企业的利润增速仍未,财

政收入中企业所得税收入10月、11月连续两个月负增长,而2018年上半年,工

业企业利润的增速还在17%,从各种迹象来看,我们判断经济下行的速度可能比

较快,因此从行业配置上,我们调整了一些行业的配置比重,例如白酒和保险的配

置大幅调减,更加偏向消费中必需消费的部分,比如牛奶、纸巾等有医药。我们

看好主要供应受到海外制约的品种,景气周期大概率向上的板块,如原煤开采设

备行业和农产品行业,并选择一部份受益成本下降的行业对此作出一定的平衡。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末圆信永丰优加生活股票型证券投资基金资产净值为1,213.31</